

# 南方优选价值混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2016年01月01日起至06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>39</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	40
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方优选价值混合型证券投资基金
基金简称	南方优选价值混合
基金主代码	202011
前端交易代码	202011
后端交易代码	202012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月18日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	772,637,412.38份
基金合同存续期	不定期

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方价值”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，采用自下而上优选的模式，投资于资产价值有保障、并且具备价值释放条件（盈利能力持续稳定或处于经营反转）的上市公司，实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	采用“自下而上”的策略，比较上市公司的现有账面资产价值与股票投资价值，优选未来价值能够释放（盈利能力持续稳定或处于经营反转，未来两年盈利增长高于GDP增长）的上市公司作为主要投资对象。同时结合“自上而下”的行业分析，根据对宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以发现能够改变个股未来价值释放能力的系统性条件，从而以最低的组合风险优选并确定最优质的股票组合。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	洪渊
	联系电话	0755-82763888	010-66105799

	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		吴万善	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-149,801,171.79
本期利润	-214,308,528.44
加权平均基金份额本期利润	-0.3023
本期加权平均净值利润率	-22.73%
本期基金份额净值增长率	-17.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	261,690,733.30
期末可供分配基金份额利润	0.3387
期末基金资产净值	1,072,061,346.74
期末基金份额净值	1.388

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	245.79%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

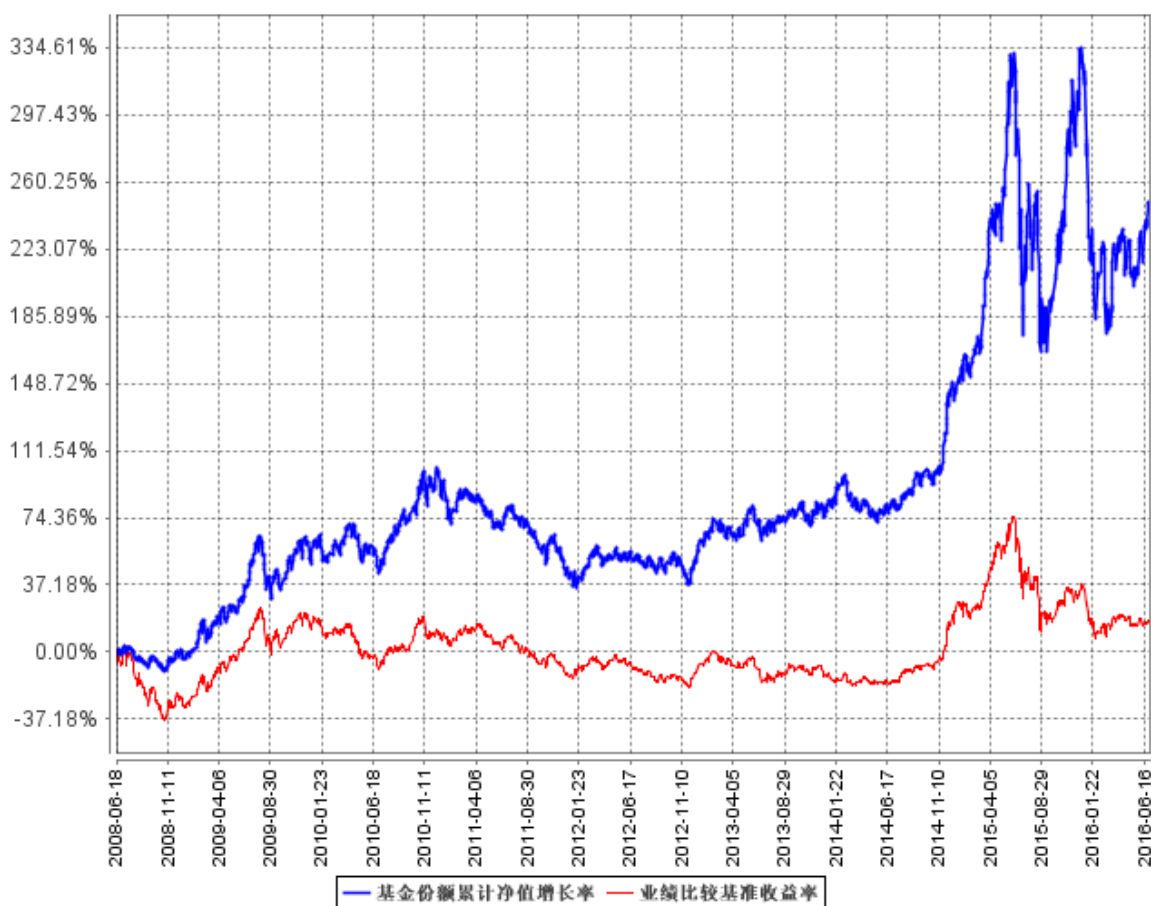
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.93%	1.68%	-0.32%	0.78%	8.25%	0.90%
过去三个月	6.04%	1.62%	-1.42%	0.81%	7.46%	0.81%
过去六个月	-17.20%	2.49%	-11.93%	1.47%	-5.27%	1.02%
过去一年	0.31%	2.77%	-22.77%	1.84%	23.08%	0.93%
过去三年	108.79%	1.95%	39.74%	1.47%	69.05%	0.48%
自基金合同生效起至今	245.79%	1.56%	17.44%	1.45%	228.35%	0.11%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过5,600亿元，旗下



管理 96 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
骆帅	本基金基金经理	2015年6月19日	-	6年	清华大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格，2009年7月加入南方基金，担任研究部研究员、高级研究员；2014年3月至2015年5月，任南方成份、南方安心基金经理助理；2015年5月至今，任南方高端装备基金经理；2015年6月至今，任南方价值、南方成长基金经理。
罗安安	本基金基金经理	2015年7月10日	-	5年	清华大学计算机科学与技术专业博士，具有基金从业资格，2010年7月加入南方基金，担任研究部高级研究员；2014年3月至2014年11月，担任南方成长、南方价值基金经理助理；2014年11月至2015年7月，担任投资经理；2015年7月至今，任南方价值基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方优选价值混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及

投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次，是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年上半年A股走势分为两个阶段：首先，由于经济基本面预期持续走弱、人民币过快贬值预期、外围市场波动剧烈等因素，导致开年暴跌，随着投资者短期投机和避险情绪明显，整个一季度市场都表现为巨幅震荡。其次，进入二季度后，由于市场对于人民币信心逐渐恢复以及美国推迟加息、监管层稳定市场加强监管等因素，A股逐渐回暖，投资者在底部积极建仓并选择结构性的反弹方向。虽然指数在二季度上涨了9%，但不少主题或板块的涨幅都超过30%，给与公募基金相对充分的时间和空间进行板块配置和个股精选的机会，二季度公募基金整体净值走势是显著好于指数的。总结，上半年A股走势是风险和机会并存，如何规避风险、把握机会考验着每一个投资者。

报告期内，由于去年底仓位配置集中在TMT等新兴成长板块，导致本基金一季度没能及时降仓躲过年初的暴跌，基金净值波动较大。在2月份我们及时调整配置结构，将部分预期较高、主题概念为主的新兴成长板块趁着指数反弹时机及时调出组合。进入二季度，我们积极参与市场反弹行情，配置主要方向是电子、军工、新能源等板块，同时在二季度末开始配置白酒、家电等相对低估值品种，增加组合的均衡性，毕竟市场存量资金博弈特征明显，前期反弹幅度较大的板块面临回调风险。目前仓位维持在80%左右，配置结构相对均衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.388 元，本报告期份额净值增长率为-17.20%，同期业绩比较基准增长率为-11.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年三季度，宏观经济在二季度整体企稳回升基础上，PMI 重回荣枯线上，CPI 短期见高点，美国 9 月之前大概率不会加息，人民币兑美元汇率近期已有较大调整，提前释放了联储加息的冲击。对房地产泡沫主动收缩、对杠杆的主动控制，实质上贬值的客观压力在减小而非加重。以上都给央行持续宽松托底经济带来政策操作空间。总体上，外围环境有利于市场的信心稳定。而监管层虽然陆续出台严厉政策加强金融监管，严控交易投机和不合理转型并购行为，长期看对于市场的稳定和蓝筹股的回归起到积极作用。从机构角度看，目前指数点位上增量资金的流入将保持相对稳健的速度，系统性风险的概率很小，结构性价值洼地和结构性新兴泡沫并存，市场有底但既有反弹也有反复，结构强势+波动剧烈是主要特征。波动中要敢于逆市操作会更有效。上证指数预计窄幅振荡，创业板波动幅度更大，但总体仍将维持向上。

未来我们将维持相对中性仓位，淡化指数对于组合的影响，而采取“仓位稳健，结构激进”的操作原则。结构上，我们相对看淡行业配置的作用，更多精力用于个股选择，精选业绩和估值具有向上弹性的标的，主要倾向于两类：业绩增长持续估值偏低分红率高的白马股；新兴热点主题里具有明显竞争力，前期涨幅不大但未来业绩估值都具有向上弹性的龙头品种，未来将根据风险偏好的变化以及指数点位，冷静判断，灵活操作，等待新的反弹良机，努力为基民提升基金净值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上

的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每类基金份额的每年收益分配次数最多为 12 次，各基金份额类别全年分配比例不得低于该类基金份额年度可供分配收益的 50%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金 A 类基金份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类基金份额净值自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；目前本基金 H 类基金份额收益分配方式仅为现金分红；如未来条件允许，本基金 H 类基金份额可增加红利再投资的收益分配方式供 H 类基金份额持有人选择，该项调整须经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案并公告后实施，无需召开基金份额持有人大会审议；增加红利再投资的收益分配后，如 H 类基金份额持有人未选择，本基金 H 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有收益分配事项。

本报告期内 2016 年 1 月 20 日已分配数（每 10 份基金份额派发红利 6.06 元）为以往年度收益分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## **§5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对南方优选价值混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，南方优选价值混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方优选价值混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方优选价值混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 328,186,030.17 元。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方优选价值混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：南方优选价值混合型证券投资基金  
报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	123,043,728.19	118,876,271.79
结算备付金		5,133,630.74	11,253,556.18
存出保证金		1,111,605.14	1,583,083.51
交易性金融资产	6.4.4.2	953,229,723.42	1,164,506,340.87
其中：股票投资		953,229,723.42	1,164,506,340.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		7,671,791.28	15,946,601.35
应收利息	6.4.4.5	27,395.01	41,571.13
应收股利		-	-
应收申购款		1,445,114.84	2,414,849.54
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		1,091,662,988.62	1,314,622,274.37
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,798,323.62	-
应付赎回款		6,076,559.24	7,240,553.71
应付管理人报酬		1,276,301.62	1,587,129.27
应付托管费		212,716.96	264,521.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	4,013,577.76	5,672,298.27
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	224,162.68	117,619.49
负债合计		19,601,641.88	14,882,122.28
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.4.9	772,637,412.38	533,970,935.85
未分配利润	6.4.4.10	299,423,934.36	765,769,216.24
所有者权益合计		1,072,061,346.74	1,299,740,152.09
负债和所有者权益总计		1,091,662,988.62	1,314,622,274.37

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.388 元，基金份额总额 772,637,412.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方优选价值混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
<b>一、收入</b>		-192,237,142.72	604,919,775.93
1.利息收入		742,558.44	1,139,681.45
其中：存款利息收入	6.4.4.11	742,558.44	930,048.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	209,633.21

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-128,714,048.45	647,563,867.88
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-130,881,273.55	640,091,875.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	2,167,225.10	7,471,992.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-64,507,356.65	-45,730,627.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	241,703.94	1,946,854.51
<b>减：二、费用</b>		22,071,385.72	21,956,550.75
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	7,032,292.09	11,722,969.96
2. 托管费	6.4.7.2.2	1,172,048.67	1,953,828.34
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	13,658,563.44	8,080,346.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.20	208,481.52	199,406.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-214,308,528.44	582,963,225.18
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-214,308,528.44	582,963,225.18

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方优选价值混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	533,970,935.85	765,769,216.24	1,299,740,152.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-214,308,528.44	-214,308,528.44

期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	238,666,476.53	76,149,276.73	314,815,753.26
其中：1.基金申购款	391,913,805.74	140,119,196.20	532,033,001.94
2.基金赎回款	-153,247,329.21	-63,969,919.47	-217,217,248.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-328,186,030.17	-328,186,030.17
五、期末所有者权益(基金净值)	772,637,412.38	299,423,934.36	1,072,061,346.74
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	888,355,367.19	556,311,392.41	1,444,666,759.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	582,963,225.18	582,963,225.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-320,643,841.13	-419,286,033.47	-739,929,874.60
其中：1.基金申购款	722,438,074.22	624,533,345.91	1,346,971,420.13
2.基金赎回款	-1,043,081,915.35	-1,043,819,379.38	-2,086,901,294.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-147,336,626.73	-147,336,626.73
五、期末所有者权益(基金净值)	567,711,526.06	572,651,957.39	1,140,363,483.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

基金管理人负责人

徐超

主管会计工作负责人

徐超

会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	123,043,728.19
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	123,043,728.19

##### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	860,316,829.41	953,229,723.42	92,912,894.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	860,316,829.41	953,229,723.42	92,912,894.01

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

##### 6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	24,865.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,079.09
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	450.18
合计	27,395.01

#### 6.4.4.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,013,577.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,013,577.76

#### 6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	25,256.70
预提费用	198,905.98
合计	224,162.68

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	533,970,935.85	533,970,935.85
本期申购	391,913,805.74	391,913,805.74
本期赎回(以“-”号填列)	-153,247,329.21	-153,247,329.21
本期末	772,637,412.38	772,637,412.38

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	647,050,937.37	118,718,278.87	765,769,216.24
本期利润	-149,801,171.79	-64,507,356.65	-214,308,528.44
本期基金份额交易产生的变动数	92,626,997.89	-16,477,721.16	76,149,276.73
其中：基金申购款	163,094,305.35	-22,975,109.15	140,119,196.20
基金赎回款	-70,467,307.46	6,497,387.99	-63,969,919.47
本期已分配利润	-328,186,030.17	-	-328,186,030.17
本期末	261,690,733.30	37,733,201.06	299,423,934.36

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	667,113.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	60,718.55
其他	14,726.19
合计	742,558.44

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	4,542,983,184.69
减：卖出股票成本总额	4,673,864,458.24
买卖股票差价收入	-130,881,273.55

#### 6.4.4.13 债券投资收益

注：无。

#### 6.4.4.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.4.15 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,167,225.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,167,225.10

#### 6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-64,507,356.65
——股票投资	-64,507,356.65
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-64,507,356.65

#### 6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	188,419.30
基金转换费收入	53,284.64
合计	241,703.94

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。 2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	13,658,563.44
银行间市场交易费用	-
合计	13,658,563.44

#### 6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	575.54
账户维护费	9,000.00
合计	208,481.52

### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.5.1 或有事项

无。

#### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.6 关联方关系

##### 6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	1,159,247,966.70	12.78%	382,614,289.91	7.41%

###### 6.4.7.1.2 权证交易

注：无。

###### 6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	1,056,423.86	12.71%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	338,575.38	7.32%	130,381.90	4.45%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。 2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,032,292.09	11,722,969.96
其中：支付销售机构的客户维护费	1,128,444.36	1,559,586.07

注：支付基金管理人南方基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,172,048.67	1,953,828.34

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 6.4.7.2.3 销售服务费

注：无。

### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。



#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国工商银行	123,043,728.19	667,113.70	174,649,236.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

##### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.8 利润分配情况

##### 6.4.8.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年1月 20日	-	2016年 1月 20日	6.0600	184,436,649.85	143,749,380.32	328,186,030.17	
合计				6.0600	184,436,649.85	143,749,380.32	328,186,030.17	

##### 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

###### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	7,889	102,399.22	102,399.22	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月4日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大事项停牌	50.58	-	-	949,000	36,495,738.41	48,000,420.00	-
300323	华灿光电	2016年4月18日	重大事项停牌	8.99	-	-	1,191,200	9,979,777.77	10,708,888.00	-
300061	康耐特	2016年5月5日	重大事项停牌	28.84	2016年7月21日	31.56	316,795	8,137,240.43	9,136,367.80	-
300338	开元仪器	2016年4月15日	重大事项停牌	18.20	-	-	441,900	8,022,868.22	8,042,580.00	-
002355	兴民钢圈	2016年5月12日	重大事项停牌	19.35	-	-	263,300	4,821,765.55	5,094,855.00	-

300508	维宏股份	2016年6月30日	股票异常波动	254.50	2016年7月6日	242.00	10,383	208,490.64	2,642,473.50	-
601611	中国核建	2016年6月30日	股票异常波动	20.92	2016年7月1日	23.01	23,193	80,479.71	485,197.56	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

## 6.4.10 金融工具风险及管理

### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.10.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

#### **6.4.10.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家上市公司的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.9 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.10.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.10.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### **6.4.10.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	123,043,728.19	-	-	-	123,043,728.19
结算备付金	5,133,630.74	-	-	-	5,133,630.74
存出保证金	1,111,605.14	-	-	-	1,111,605.14
交易性金融资产	-	-	-	953,229,723.42	953,229,723.42
应收证券清算款	-	-	-	7,671,791.28	7,671,791.28
应收利息	-	-	-	27,395.01	27,395.01
应收申购款	360,786.57	-	-	1,084,328.27	1,445,114.84
资产总计	129,649,750.64	-	-	962,013,237.98	1,091,662,988.62
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,798,323.62	7,798,323.62
应付赎回款	-	-	-	6,076,559.24	6,076,559.24
应付管理人报酬	-	-	-	1,276,301.62	1,276,301.62
应付托管费	-	-	-	212,716.96	212,716.96
应付交易费用	-	-	-	4,013,577.76	4,013,577.76
其他负债	-	-	-	224,162.68	224,162.68
负债总计	-	-	-	19,601,641.88	19,601,641.88
利率敏感度缺口	129,649,750.64	-	-	942,411,596.10	1,072,061,346.74
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	118,876,271.79	-	-	-	118,876,271.79
结算备付金	11,253,556.18	-	-	-	11,253,556.18
存出保证金	1,583,083.51	-	-	-	1,583,083.51
交易性金融资产	-	-	-	1,164,506,340.87	1,164,506,340.87
应收证券清算款	-	-	-	15,946,601.35	15,946,601.35
应收利息	-	-	-	41,571.13	41,571.13
应收申购款	414,035.57	-	-	2,000,813.97	2,414,849.54
资产总计	132,126,947.05	-	-	1,182,495,327.32	1,314,622,274.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,240,553.71	7,240,553.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,587,129.27	1,587,129.27
应付托管费	-	-	-	264,521.54	264,521.54
应付交易费用	-	-	-	5,672,298.27	5,672,298.27
其他负债	-	-	-	117,619.49	117,619.49
负债总计	-	-	-	14,882,122.28	14,882,122.28
利率敏感度缺口	132,126,947.05	-	-	1,167,613,205.04	1,299,740,152.09

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.10.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产净值的 60%-95%；债券、货币市场工具及其他金融工具占基金资产净值的 0-35%；权证占基金资产净值的 0-3%；资产支持证券占基金资产净值的 0-20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)

		(%)		
交易性金融资产-股票投资	953,229,723.42	88.92	1,164,506,340.87	89.60
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	953,229,723.42	88.92	1,164,506,340.87	89.60

#### 6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	约 6,336	约 5,942
	2. 沪深 300 指数下降 5%	约-6,336	约-5,942

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	953,229,723.42	87.32
	其中：股票	953,229,723.42	87.32
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	128,177,358.93	11.74
7	其他各项资产	10,255,906.27	0.94
8	合计	1,091,662,988.62	100.00



## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	191,361.36	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	698,811,316.33	65.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,020,000.00	1.87
E	建筑业	45,750,333.57	4.27
F	批发和零售业	106,248.66	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	67,009,207.54	6.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,778,335.11	9.03
J	金融业	420,264.00	0.04
K	房地产业	12,920,000.00	1.21
L	租赁和商务服务业	11,084,645.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	136,807.85	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,204.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	953,229,723.42	88.92

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002572	索菲亚	925,384	51,840,011.68	4.84
2	300038	梅泰诺	949,000	48,000,420.00	4.48
3	603002	宏昌电子	5,999,894	46,079,185.92	4.30
4	000065	北方国际	1,400,097	45,265,136.01	4.22
5	300278	华昌达	2,500,000	42,725,000.00	3.99
6	601689	拓普集团	1,282,380	42,254,421.00	3.94
7	300456	耐威科技	605,993	41,056,025.75	3.83

8	000429	粤高速 A	7,000,060	38,500,330.00	3.59
9	000333	美的集团	1,500,000	35,580,000.00	3.32
10	300014	亿纬锂能	700,070	30,236,023.30	2.82
11	300101	振芯科技	999,923	27,927,849.39	2.61
12	603678	火炬电子	351,060	26,757,793.20	2.50
13	300252	金信诺	800,000	26,504,000.00	2.47
14	300342	天银机电	857,000	26,104,220.00	2.43
15	002108	沧州明珠	1,000,000	25,900,000.00	2.42
16	300465	高伟达	299,984	22,540,797.76	2.10
17	300100	双林股份	503,577	22,061,708.37	2.06
18	600419	天润乳业	408,142	21,994,772.38	2.05
19	300017	网宿科技	300,021	20,161,411.20	1.88
20	000421	南京中北	2,000,000	20,020,000.00	1.87
21	002361	神剑股份	2,514,463	19,512,232.88	1.82
22	002354	天神娱乐	200,000	17,456,000.00	1.63
23	300340	科恒股份	199,950	15,842,038.50	1.48
24	600666	奥瑞德	448,400	15,586,384.00	1.45
25	300177	中海达	1,000,000	15,160,000.00	1.41
26	600303	曙光股份	999,989	14,849,836.65	1.39
27	600270	外运发展	840,396	14,698,526.04	1.37
28	002537	海立美达	444,100	13,500,640.00	1.26
29	600565	迪马股份	2,000,000	12,920,000.00	1.21
30	300469	信息发展	100,000	12,672,000.00	1.18
31	002456	欧菲光	400,000	11,800,000.00	1.10
32	300468	四方精创	149,950	11,346,716.50	1.06
33	603598	引力传媒	460,900	11,084,645.00	1.03
34	002508	老板电器	300,000	11,031,000.00	1.03
35	300323	华灿光电	1,191,200	10,708,888.00	1.00
36	300482	万孚生物	200,000	10,590,000.00	0.99
37	002245	澳洋顺昌	799,950	10,215,361.50	0.95
38	000404	华意压缩	1,000,000	9,620,000.00	0.90
39	300061	康耐特	316,795	9,136,367.80	0.85
40	300338	开元仪器	441,900	8,042,580.00	0.75
41	600110	诺德股份	660,000	6,494,400.00	0.61
42	300467	迅游科技	100,000	6,188,000.00	0.58
43	000568	泸州老窖	200,000	5,940,000.00	0.55
44	002355	兴民钢圈	263,300	5,094,855.00	0.48
45	002624	完美环球	98,025	3,700,443.75	0.35
46	300350	华鹏飞	100,700	3,594,990.00	0.34

47	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	0.25
48	601611	中国核建	23,193	485,197.56	0.05
49	002797	第一创业	10,400	420,264.00	0.04
50	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.02
51	300511	雪榕生物	2,872	191,361.36	0.02
52	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.02
53	603779	威龙股份	2,809	117,865.64	0.01
54	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.01
55	603101	汇嘉时代	3,563	106,248.66	0.01
56	601966	玲珑轮胎	7,889	102,399.22	0.01
57	300078	思创医惠	2,200	73,568.00	0.01
58	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.01
59	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
60	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
61	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
62	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
63	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
64	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
65	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
66	000888	峨眉山A	100	1,204.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300033	同花顺	56,718,220.50	4.36
2	002668	奥马电器	56,705,562.53	4.36
3	000421	南京公用	53,477,564.39	4.11
4	300467	迅游科技	51,755,949.08	3.98
5	000429	粤高速A	48,690,994.13	3.75
6	300078	思创医惠	47,712,160.69	3.67
7	601689	拓普集团	47,569,101.20	3.66
8	300350	华鹏飞	46,580,028.50	3.58
9	000158	常山股份	45,320,231.74	3.49
10	300085	银之杰	43,819,066.53	3.37

11	000065	北方国际	41,872,003.35	3.22
12	300008	天海防务	41,548,299.49	3.20
13	600303	曙光股份	41,516,194.95	3.19
14	300278	华昌达	41,463,965.71	3.19
15	002530	丰东股份	40,010,615.91	3.08
16	300100	双林股份	39,969,042.54	3.08
17	300456	耐威科技	39,826,938.00	3.06
18	002108	沧州明珠	39,427,938.74	3.03
19	603002	宏昌电子	39,390,079.47	3.03
20	002769	普路通	39,368,407.10	3.03
21	300340	科恒股份	38,907,904.60	2.99
22	002020	京新药业	38,582,636.40	2.97
23	300384	三联虹普	37,189,594.66	2.86
24	603678	火炬电子	37,182,278.22	2.86
25	000606	*ST 易桥	36,591,558.81	2.82
26	002572	索菲亚	36,302,882.75	2.79
27	300014	亿纬锂能	36,277,431.99	2.79
28	000333	美的集团	35,231,078.37	2.71
29	300465	高伟达	35,221,962.85	2.71
30	300440	运达科技	35,190,874.27	2.71
31	002667	鞍重股份	34,920,954.07	2.69
32	002624	完美环球	33,928,516.81	2.61
33	600547	山东黄金	33,823,721.50	2.60
34	300476	胜宏科技	32,013,961.19	2.46
35	300418	昆仑万维	31,203,461.47	2.40
36	000807	云铝股份	30,485,989.17	2.35
37	300166	东方国信	30,463,965.09	2.34
38	002245	澳洋顺昌	30,454,745.35	2.34
39	601777	力帆股份	30,358,808.28	2.34
40	300252	金信诺	30,237,648.56	2.33
41	600548	深高速	29,817,864.30	2.29
42	300364	中文在线	28,943,192.37	2.23
43	300017	网宿科技	28,842,011.47	2.22
44	300426	唐德影视	28,715,797.24	2.21
45	300469	信息发展	26,541,549.50	2.04
46	000821	京山轻机	26,529,544.76	2.04

47	002335	科华恒盛	26,442,341.91	2.03
48	600419	天润乳业	26,194,070.21	2.02
49	300431	暴风集团	26,066,360.22	2.01
50	000423	东阿阿胶	26,054,813.76	2.00
51	300101	振芯科技	26,018,538.46	2.00

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300078	思创医惠	96,127,455.09	7.40
2	300467	迅游科技	76,288,151.76	5.87
3	600734	实达集团	66,761,342.61	5.14
4	300033	同花顺	62,653,508.31	4.82
5	002667	鞍重股份	55,693,738.95	4.28
6	300350	华鹏飞	53,443,483.89	4.11
7	002668	奥马电器	51,559,890.32	3.97
8	300366	创意信息	51,236,425.24	3.94
9	600446	金证股份	48,378,027.94	3.72
10	000158	常山股份	46,518,374.54	3.58
11	300008	天海防务	45,906,303.49	3.53
12	300085	银之杰	43,106,116.04	3.32
13	000666	经纬纺机	42,726,087.49	3.29
14	300340	科恒股份	41,751,604.08	3.21
15	002769	普路通	40,396,479.15	3.11
16	002530	丰东股份	40,340,875.45	3.10
17	300202	聚龙股份	40,059,196.08	3.08
18	002466	天齐锂业	38,302,696.03	2.95
19	603636	南威软件	37,871,911.14	2.91
20	600485	信威集团	37,484,567.39	2.88
21	002445	中南文化	36,919,639.63	2.84
22	002020	京新药业	36,869,087.63	2.84
23	000421	南京公用	35,656,747.69	2.74
24	601777	力帆股份	35,313,801.26	2.72
25	300418	昆仑万维	35,251,968.38	2.71
26	300440	运达科技	33,826,321.39	2.60

27	600547	山东黄金	33,603,218.95	2.59
28	300384	三联虹普	33,526,479.79	2.58
29	300476	胜宏科技	33,066,320.69	2.54
30	002624	完美环球	32,962,890.08	2.54
31	600303	曙光股份	32,657,735.92	2.51
32	000606	*ST 易桥	32,492,368.43	2.50
33	000697	炼石有色	31,762,821.12	2.44
34	300166	东方国信	31,041,220.25	2.39
35	300364	中文在线	30,434,965.55	2.34
36	002313	日海通讯	29,596,859.98	2.28
37	600548	深高速	29,102,246.15	2.24
38	300100	双林股份	28,928,181.07	2.23
39	001979	招商蛇口	28,704,411.18	2.21
40	000807	云铝股份	27,944,311.05	2.15
41	300426	唐德影视	27,723,635.84	2.13
42	000821	京山轻机	26,904,524.66	2.07
43	002335	科华恒盛	26,330,413.56	2.03
44	000423	东阿阿胶	26,308,896.54	2.02

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,527,095,197.44
卖出股票收入（成交）总额	4,542,983,184.69

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除宏昌电子(603002)外，本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。根据2015年5月22日宏昌电子材料股份有限公司（下称宏昌电子，股票代码：603002）《宏昌电子材料股份有限公司关于收到广州市萝岗区环境保护和城市管理局行政处罚、责令限制生产决定书》，宏昌电子收到广州市萝岗区环境保护和城市管理局（以下简称“萝岗环保局”）《行政处罚决定书》（穗萝环罚

【2015】9号）、《责令限制生产决定书》（穗萝环限决字【2015】5号），萝岗环保局认定，在公司正常生产的情况下，经广东维中检测技术有限公司检测，公司P0T-791废气排放口排放的大气污染物中，甲苯、二甲苯及非甲烷总烃的浓度平均值超出了广东省地方标准最高允许排放浓度限值，决定对公司罚款人民币9万元，责令公司限制生产三个月，限制生产期间，公司生产产能不得超过建设项目环保竣工验收产能的50%，具体限制生产的改正方式以能达到达标排放目的为准。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,111,605.14
2	应收证券清算款	7,671,791.28

3	应收股利	-
4	应收利息	27,395.01
5	应收申购款	1,445,114.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,255,906.27

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300038	梅泰诺	48,000,420.00	4.48	重大事项停牌

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
63,799	12,110.49	75,699,470.09	9.80%	696,937,942.29	90.20%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,101,344.06	0.2720%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	--------------------



本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年6月18日）基金份额总额	1,139,765,865.76
本报告期期初基金份额总额	533,970,935.85
本报告期基金总申购份额	391,913,805.74
减：本报告期基金总赎回份额	153,247,329.21
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	772,637,412.38

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	1,359,023,592.11	14.99%	1,242,867.66	14.95%	-
华泰证券	2	1,159,247,966.70	12.78%	1,056,423.86	12.71%	-
广发证券	2	894,674,624.58	9.87%	827,606.05	9.96%	-
方正证券	1	778,188,315.69	8.58%	709,163.56	8.53%	-
平安证券	1	667,983,936.12	7.37%	608,733.98	7.32%	-
银河证券	2	664,069,435.48	7.32%	605,166.99	7.28%	-
国信证券	1	648,179,811.84	7.15%	590,687.11	7.11%	-
信达证券	1	516,694,115.95	5.70%	481,198.43	5.79%	-
海通证券	1	505,508,147.11	5.57%	460,671.21	5.54%	-
招商证券	1	496,324,933.10	5.47%	462,226.62	5.56%	-
中信建投	2	415,400,222.32	4.58%	384,488.61	4.63%	-
上海证券	1	399,908,980.25	4.41%	364,437.23	4.38%	-
西南证券	1	381,983,713.56	4.21%	348,102.84	4.19%	-
华安证券	1	145,283,341.60	1.60%	135,301.94	1.63%	-
中泰证券	1	36,485,723.55	0.40%	33,979.05	0.41%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期新增租用3家证券公司的3个交易单元，分别为方正证券股份有限公司（深圳）、平安证券有限责任公司（深圳）和西南证券股份有限公司（深圳）。

2、交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元：

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

- b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月30日
2	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月30日
3	南方基金关于旗下部分基金增加余杭农村商业银行作为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月23日
4	南方基金关于旗下部分基金增加晋商银行和贵阳银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月23日
5	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月3日
6	南方基金关于旗下部分基金增加泰隆银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月3日
7	南方基金关于旗下部分基金增加江苏银行和南充市商业银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年5月27日
8	南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年5月13日
9	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年5月12日
10	南方基金关于旗下部分基金增加潍坊银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年4月26日

11	南方基金关于旗下部分基金增加徽商期货为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年4月18日
12	南方基金关于旗下部分基金增加德州银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年4月15日
13	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年4月12日
14	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年3月31日
15	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年3月9日
16	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年2月4日
17	南方基金关于旗下部分基金增加陆金所资管、唐鼎耀华为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年2月1日
18	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月27日
19	南方基金关于旗下部分基金增加昆仑银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月26日
20	南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月26日
21	南方优选价值混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月18日
22	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为0的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月15日
23	南方基金关于旗下部分基金增加贵阳银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月15日
24	南方基金管理有限公司关于在2016年1月	中国证券报、上海	2016年1月7日

	7日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	证券报、证券时报	
25	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月5日
26	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月5日
27	南方基金管理有限公司关于在2016年1月4日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月4日
28	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月4日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方优选价值股票型证券投资基金（现已更名为南方优选价值混合型证券投资基金）的文件。
- 2、《南方优选价值混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《南方优选价值混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

### 11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>